

**Руководство пользователя
для FIX API
к OTC системе**

**г. Москва
2020**

1 Оглавление

2	Общее описание	4
2.1	Состав документа	4
2.2	Рекомендация разработчикам	4
2.3	Описание сообщений	4
3	Сессионный уровень и стандартные заголовки	4
3.1	Заголовок StandardHeader	4
3.2	Трейлер StandardTrailer	5
3.3	Сообщение Logon	5
3.4	Сообщение HeartBeat	6
3.5	Сообщение Reject	6
4	Описание сообщений	6
4.1	Сообщение IOI	6
4.2	Сообщение QuoteResponse	9
4.3	Сообщение QuoteCancel	12
4.4	Сообщение QuoteAck	12
4.5	Сообщение Quote	13
4.6	Сообщение BusinessMessageReject	15
4.7	Сообщение NewOrderSingle	15
4.8	Сообщение OrderCancelRequest	18
4.9	Сообщение OrderCancelReject	18
4.10	Сообщение SecurityListRequest	19
4.11	Сообщение SecurityList	19
4.12	Сообщение ExecutionReport	20
4.13	Сообщение PartyDetailsListRequest	23
4.14	Сообщение PartyDetailsListReport	24
4.15	Сообщени SecurityListRequest для коммерческих облигаций	24
4.15.1	Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций	25
4.16	Сообщение PricingFactorRequest для коммерческих облигаций	27
4.16.1	Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций	28
4.17	Сообщение CouponPeriodRequest для коммерческих облигаций	29
4.17.1	Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций	30
4.18	Сообщение AmortizationPeriodRequest для коммерческих облигаций	32
4.18.1	Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций	33
5	Получение пропущенных данных и истории	34

5.1	Общее описание	34
5.2	Получение пропущенных данных	35
5.3	Получение истории	35
5.4	Описание сообщений для истории и пропущенных данных	35
6	Описание компонентов	36
6.1	Компонента Instrument	36
6.2	Компонента SecAltIDGrp	37
6.3	Компонента SecurityTradingRules	37
6.4	Компонента BaseTradingRules	37
6.5	Компонента TickRules	38
6.6	Компонента LotTypeRules	38
6.7	Компонента PriceLimits	38
6.8	Компонента Parties	39
6.9	Компонента MiscFeesGrp	39
6.10	Компонента SecListGrp	40
6.11	Компонента PartyDetailGrp	40
6.12	Компонента PartyDetailSubGrp	40
6.13	Компонента CommissionData	40
6.14	Компонента DiscretionInstructions	41
6.15	Компонента InstrumentExtention	41
6.16	Компонента AttrGrp	41
7	Диаграммы сообщений и комментарии	43
7.1	Сообщения IOI	43
7.2	Обмен сообщениями QUOTE	43
7.3	Обмен сообщениями для ORDER	44
7.4	Отмена переговоров	46
7.5	Получение адресных сообщений	46
7.6	Получение инструментов и контрагентов	46

2 Общее описание

Данный документ содержит руководство пользователя для FIX API к OTC системе.

Документ содержит описание сообщений, блоков и полей протокола FIX версии 5.0 sp2, адаптированного для использования в системе OTC. Описание интерфейса базируется на спецификации протокола FIX (Financial Information Exchange, <http://www.fixprotocol.org>) версии 5.0 sp2; предполагается, что читатель уже знаком с основами этого протокола.

2.1 Состав документа

В документе содержатся следующие части протокола FIX:

- стандартные поля заголовка «StandardHeader»;
- стандартные поля заголовка «StandardTrailer»;
- Список сообщений протокола с полями;
- Описание полей и групп полей;
- Примеры Типовых сценариев использования протокола.

2.2 Рекомендация разработчикам

В отдельных случаях в сообщениях сервера могут без достаточного времени на уведомление добавляться необязательные поля, не являющиеся необходимыми для большинства клиентов. Настоятельно рекомендуется проектировать клиентские приложения так, чтобы они без сбоев могли игнорировать поля сообщений сервера, смысл которых приложению неизвестен.

2.3 Описание сообщений

Каждое сообщение (группа) описывается таблицей. Каждая строка в таблице это - поле сообщения (группы). Для каждого поля указаны:

- Tag – число, которое непосредственно используется при формировании FIX сообщения.
- Поле – приведено имя поля, которое не используется при формировании FIX сообщения; введено для удобства, в качестве краткого описания. В документации FIX поле может быть указано как с использованием Tag, так и с использованием Field name.
- Описание - описание поле, возможные значения поля.
- Тип данных - опи
- Наличие – атрибут поля, который показывает, должно ли поле обязательно присутствовать в сообщении.
 - «Y» - обязательное поле;
 - «N» - необязательное поле.

3 Сессионный уровень и стандартные заголовки

3.1 Заголовок StandardHeader

Стандартный заголовок StandardHeader содержит следующие поля сообщения.

- О – обязательность;
- Y – обязательное поле;
- N – необязательное;

Tag	Поле сообщения	Описание	O
8	BeginString	Определяет начало нового сообщения и версию протокола. Всегда содержит незашифрованные данные, должно быть первым полем в сообщении.	Y
9	BodyLength	Длина сообщения. Рассчитывается в соответствии со стандартом. Всегда содержит незашифрованные данные, должно быть вторым полем в сообщении.	Y
35	MsgType	Определяет тип сообщения. Всегда содержит незашифрованные данные, должно быть третьим полем в сообщении.	Y
49	SenderCompID	Идентификатор фирмы – отправителя сообщения.	Y
56	TargetCompID	Идентификатор фирмы – получателя сообщения.	Y
34	MsgSeqNum	Порядковый номер сообщения.	Y
43	PossDupFlag	Идентификатор, показывающий возможную повторную пересылку сообщения под тем же порядковым номером.	N
97	PossResend	Индикатор, показывающий, что сообщение может содержать информацию, которая была отправлена под другим порядковым номером.	N
52	SendingTime	Время передачи сообщения (выражено в формате UTC)	N
122	OrigSendingTime	оригинальное время передачи сообщения при пересылке сообщений в ответ на запрос о пересылке (сообщение Resend Request (2)), выражено в UTC формате	N

3.2 Трейлер StandardTrailer

StandardTrailer			
Tag	Поле сообщения	Описание	O
10	Checksum	Контрольная сумма	Y

3.3 Сообщение Logon

Сообщение, инициирующее или подтверждающее установку сессии. Должно быть первым сообщением в каждом подключении.

Logon			
Tag	Поле сообщения	Описание	O
	StandardHeader	MsgType = A	Y
98	EncryptMethod	Метод шифрования. Шифрование не используется. Значение 0.	Y
108	HeartBtInt	Общее значение частоты программного обеспечения для обмена HeartBeat сообщениями	Y
1137	DefaultAppVerID	Версия по умолчанию FIX сообщений для сессии.	N
554	Password	Пароль для открытия сессии	N
	StandardTrailer	Стандартный трейлер	Y

3.4 Сообщение HeartBeat

Передаётся периодически для контроля состояния соединения.

HeartBeat			
Tag	Поле сообщения	Описание	O
	StandardHeader	MsgType = 0	Y
	StandardTrailer	Стандартный трейлер	Y

3.5 Сообщение Reject

Выдается в ответ на полученное сообщение, которое не может быть правильно обработано из-за ошибок в соблюдении протокола сессионного уровня.

Reject			
Tag	Поле сообщения	Описание	O
	StandardHeader	MsgType = 0	Y
45	RefSeqNum	Номер отвергнутого сообщения	Y
58	Text	Текст сообщения	N
	StandardTrailer	Стандартный трейлер	Y

4 Описание сообщений

В этом разделе описываются типы сообщений и содержание их полей.

4.1 Сообщение IOI

IOI (indication of interest) – индикация интереса к ценной бумаге (покупка и/или продажа), адресованная от Участника Системе;

В таблице ниже описаны поля сообщения IOI MessageType=6.

IOI MessageType=6				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
23	IOIID	STRING	Уникальный идентификатор сообщения IOI	Y
28	IOITransType	CHAR	Тип транзакции N - NEW. Новый запрос IOI C - CANCEL. Отмена запроса IOI	Y
26	IOIRefID	STRING	Обязательный для IOITransType=C - Ссылка на идентификатор отменяемого IOI	N
54	Side	CHAR	Справочник направлений 1 - BUY. Интерес в покупке 2 - SELL. Интерес в продаже	Y

			7 - UNDISCLOSED. Двухнаправленный интерес (Только IOI)	
27	IOIQty	STRING	Количество ценных бумаг, выраженное в штуках U - UNDISCLOSED_QUANTITY. Количество может быть не указано	Y
100	ExDestination	EXCHANGE	Площадка: РПС МБ (биржевая) или ОТС(внебиржевая). Идентификатор площадки: "MISX" – РПС МБ, РПС, АРПС. "XOFF" – ОТС	N
1133	ExDestinationIDSource	CHAR	Тип для поля ExDestination D - CUSTOM_CODE. Определен площадкой	N
Instrument			Финансовый инструмент	Y
Parties			Участники	N
423	PriceType	INT	Тип цены 1 - PERCENTAGE. Процент	N
44	Price	PRICE	Цена за одну ценную бумагу	N
168	EffectiveTime	TZTIMEONLY	Действительно с	N
62	ValidUntilTime	TZTIMEONLY	Действительно по	N
1091	PreTradeAnonymity	BOOLEAN	Анонимно	N
64	SettlDate	LOCALMKTDATE	Дата расчетов	N
120	SettlCurrency	CURRENCY	Валюта расчетов	N
113	ReportToExch	BOOLEAN	Отправить ли отчет в ОТС-монитор по итогам заключения сделки. Учитывается, если Место исполнения="ОТС" N - INDICATES_THE_PARTY_SENDING_MESSAGE_WILL_REPORT_TRADE. Да Y - INDICATES_THE_PARTY_RECEIVING_MESSAGE_MUST_REPORT_TRADE. Нет	N

528	OrderCapacity	CHAR	За чей счет А - AGENCY. За счет клиента Р - PRINCIPAL. За свой счет W - AGENT_FOR_OTHER_MEMBER. За счет Д.У.	N
5459	OptionSettlType	STRING	Код расчетов по сделке. Учитывается, если Место исполнения="РПС МБ"	N
7000	NotificationRule	INT	Рассылать уведомление 1 - ALL. Всем контрагентам из списка 2 - LIST. Только рейтинговым контрагентам из списка 3 - NONE. Никому	N
7001	NegotiationID	STRING	Идентификатор объекта Negotiation. Если на базе существующего IOI, то принимается из клиента	N
172	SettlDeliveryType	INT	Тип поставки 0 - VERSUS_PAYMENT_DELIVER_PAYMENT. DVP 1 - FREE_DELIVER_FREE. FOP	N
504	PaymentDate	LOCALMK TDATE	Дата платежа	N
743	DeliveryDate	LOCALMK TDATE	Дата поставки	N
155	SettlCurrFxRate	FLOAT	Курс	N
156	SettlCurrFxRateCalc	CHAR	Способ расчета курса: MULTIPLY M - MULTIPLY. D - DIVIDE.	N
1446	RateSource	INT	Источник курса: ЦБ или в ручную 0 - CENTRALBANK. 1 - MANUAL. 2 - IGNORE.	N
58	Text	STRING	Описание	N
494	Designation	STRING	Комментарий	N
7004	BrokerRef	STRING	Ссылка brokerref	N

221	BenchmarkCurveName	STRING	Источник референсной исходной цены. Интерфакс.	N
662	BenchmarkPrice	PRICE	Значение исходной цены	N
DiscretionInstructions		Параметры смещения цены		N

4.2 Сообщение QuoteResponse

В таблице ниже описаны поля сообщения QuoteResponse MessageType=AJ.

QuoteResponse MessageType=AJ				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
693	QuoteRespID	STRING	Идентификатор сообщения	Y
117	QuoteID	STRING	Идентификатор котировки	N
694	QuoteRespType	INT	Статус сообщения 90 - PENDING. Принят не обработан 91 - ANNOUNCED. Объявлен 92 - REJECTED. Отклонен 93 - MATCHED. Найден встречный 94 - CANCELED. Снят 95 - EXPIRED. Снят по времени	Y
528	OrderCapacity	CHAR	За чей счет A - AGENCY. За счет клиента P - PRINCIPAL. За свой счет W - AGENT_FOR_OTHER_MEMBER. За счет Д.У.	N
23	IOIID	STRING	Уникальный идентификатор сообщения IOI	N
1091	PreTradeAnonymity	BOOLEAN	Анонимно	N
Parties			Участники	N
Instrument			Финансовый инструмент	Y
54	Side	CHAR	Справочник направлений 1 - BUY. Интерес в покупке 2 - SELL. Интерес в продаже 7 - UNDISCLOSED. Двухнаправленный интерес (Только IOI)	N

27	IOIQty	STRING	Количество ценных бумаг, выраженное в штуках U - UNDISCLOSED_QUANTITY. Количество может быть не указано	N
28	IOITransType	CHAR	Тип транзакции N - NEW. Новый запрос IOI C - CANCEL. Отмена запроса IOI	N
26	IOIRefID	STRING	Обязательный для IOITransType=C - Ссылка на идентификатор отменяемого IOI	N
113	ReportToExch	BOOLEAN	Отправить ли отчет в ОТС-монитор по итогам заключения сделки. Учитывается, если Место исполнения="ОТС" N - INDICATES_THE_PARTY_SENDING_MESSAGE_WILL_REPORT_TRADE. Да Y - INDICATES_THE_PARTY_RECEIVING_MESSAGE_MUST_REPORT_TRADE. Нет	N
168	EffectiveTime	TZTIMEONLY	Действительно с	N
75	TradeDate	LOCALMKTDATE	Дата	N
120	SettlCurrency	CURRENCY	Валюта расчетов	N
172	SettlDeliveryType	INT	Тип поставки 0 - VERSUS_PAYMENT_DELIVER_PAYMENT.DVP 1 - FREE_DELIVER_FREE. FOP	N
64	SettlDate	LOCALMKTDATE	Дата расчетов	N
62	ValidUntilTime	TZTIMEONLY	Действительно по	N
60	TransactTime	TZTIMEONLY	Действительно с	N
100	ExDestination	EXCHANGE	Площадка: РПС МБ (биржевая) или ОТС(внебиржевая). Идентификатор	N

			площадки: "MISX" – РПС МБ, РПС, АРПС. "XOFF" – ОТС	
1133	ExDestinationIDSource	CHAR	Тип для поля ExDestination D - CUSTOM_CODE. Определен площадкой	N
44	Price	PRICE	Цена за одну ценную бумагу	N
423	PriceType	INT	Тип цены 1 - PERCENTAGE. Процент	N
5459	OptionSettlType	STRING	Код расчетов по сделке. Учитывается, если Место исполнения="РПС МБ"	N
7001	NegotiationID	STRING	Идентификатор объекта Negotiation. Если на базе существующего IOI, то принимается из клиента	N
504	PaymentDate	LOCALMK TDATE	Дата платежа	N
743	DeliveryDate	LOCALMK TDATE	Дата поставки	N
155	SettlCurrFxRate	FLOAT	Курс	N
156	SettlCurrFxRateCalc	CHAR	Способ расчета курса: MULTIPLY M - MULTIPLY. D - DIVIDE.	N
1446	RateSource	INT	Источник курса: ЦБ или в ручную 0 - CENTRALBANK. 1 - MANUAL. 2 - IGNORE.	N
58	Text	STRING	Описание	N
494	Designation	STRING	Комментарий	N
7004	BrokerRef	STRING	Ссылка brokerref	N
221	BenchmarkCurveName	STRING	Источник референсной исходной цены. Интерфакс.	N
662	BenchmarkPrice	PRICE	Значение исходной цены	N
DiscretionInstructions		Параметры смещения цены		N

4.3 Сообщение QuoteCancel

В таблице ниже описаны поля сообщения QuoteCancel MessageType=Z.

QuoteCancel MessageType=Z				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
117	QuoteID	STRING	Идентификатор котировки	N
1166	QuoteMsgID	STRING	Уникальный идентификатор сообщения о котировке	N
298	QuoteCancelType	INT	Тип критерия отмены котировок 5 - Отмена котировки	Y
Parties			Участники	N
537	QuoteType	INT	Тип котировки 0 - Индикативная котировка	N

4.4 Сообщение QuoteAck

В таблице ниже описаны поля сообщения QuoteAck MessageType=CW.

QuoteAck MessageType=CW				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
117	QuoteID	STRING	Идентификатор котировки	N
1166	QuoteMsgID	STRING	Уникальный идентификатор сообщения о котировке	Y
298	QuoteCancelType	INT	Тип критерия отмены котировок 5 - Отмена котировки	N
537	QuoteType	INT	Тип котировки 0 - Индикативная котировка	N
1865	QuoteAckStatus	INT	Статус обработки запроса, указанного в QuoteMsgID 0 - Получена, но не обработана 1 - Принята 2 - Не принята	N
300	QuoteRejectReason	INT	Причина отказа 99 -	N
1328	RejectText	STRING	Текст описания причины отказа	N
Parties			Участники	N

4.5 Сообщение Quote

В таблице ниже описаны поля сообщения Quote MessageType=S.

Quote MessageType=S				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
117	QuoteID	STRING	Идентификатор котировки	N
1166	QuoteMsgID	STRING	Уникальный идентификатор сообщения о котировке	N
537	QuoteType	INT	Тип котировки 0 - INDICATIVE. Индикативная котировка	N
2403	QuoteModelType	INT	Модель выставления котировки 1 - QUOTE_ENTRY. Выставление котировки	N
Parties			Участники	N
Instrument			Финансовый инструмент	Y
54	Side	CHAR	Справочник направлений 1 - BUY. Интерес в покупке 2 - SELL. Интерес в продаже 7 - UNDISCLOSED. Двухнаправленный интерес (Только IOI)	N
38	OrderQty	QTY	Количество ценных бумаг в единицах	N
64	SettlDate	LOCALMK TDATE	Дата расчетов	N
120	SettlCurrency	CURRENC Y	Валюта расчетов	N
100	ExDestination	EXCHANG E	Площадка: РПС МБ (биржевая) или ОТС(внебиржевая). Идентификатор площадки: "MISX" – РПС МБ, РПС, АРПС. "XOFF" – ОТС	N
1133	ExDestinationIDSource	CHAR	Тип для поля ExDestination D - CUSTOM_CODE. Определен площадкой	N
44	Price	PRICE	Цена за одну ценную бумагу	Y
423	PriceType	INT	Тип цены 1 - PERCENTAGE. Процент	Y

168	EffectiveTime	TZTIMEONLY	Действительно с	N
62	ValidUntilTime	TZTIMEONLY	Действительно по	N
5459	OptionSettlType	STRING	Код расчетов по сделке. Учитывается, если Место исполнения="РПС МБ"	N
1091	PreTradeAnonymity	BOOLEAN	Анонимно	N
172	SettlDeliveryType	INT	Тип поставки 0 - VERSUS_PAYMENT_DELIVER_PAYMENT. DVP 1 - FREE_DELIVER_FREE. FOP	N
113	ReportToExch	BOOLEAN	Отправить ли отчет в ОТС-монитор по итогам заключения сделки. Учитывается, если Место исполнения="ОТС" N - INDICATES_THE_PARTY_SENDING_MESSAGE_WILL_REPORT_TRADE. Да Y - INDICATES_THE_PARTY_RECEIVING_MESSAGE_MUST_REPORT_TRADE. Нет	N
528	OrderCapacity	CHAR	За чей счет A - AGENCY. За счет клиента P - PRINCIPAL. За свой счет W - AGENT_FOR_OTHER_MEMBER. За счет Д.У.	N
7001	NegotiationID	STRING	Идентификатор объекта Negotiation. Если на базе существующего IOI, то принимается из клиента	N
504	PaymentDate	LOCALMKTDATE	Дата платежа	N
743	DeliveryDate	LOCALMKTDATE	Дата поставки	N
155	SettlCurrFxRate	FLOAT	Курс	N
156	SettlCurrFxRateCalc	CHAR	Способ расчета курса: MULTIPLY M - MULTIPLY. D - DIVIDE.	N

1446	RateSource	INT	Источник курса: ЦБ или в ручную 0 - CENTRALBANK. 1 - MANUAL. 2 - IGNORE.	N
58	Text	STRING	Описание	N
494	Designation	STRING	Комментарий	N
7004	BrokerRef	STRING	Ссылка brokerref	N
221	BenchmarkCurveName	STRING	Источник референсной исходной цены. Интерфакс.	N
662	BenchmarkPrice	PRICE	Значение исходной цены	N
DiscretionInstructions		Параметры смещения цены		N

4.6 Сообщение BusinessMessageReject

В таблице ниже описаны поля сообщения BusinessMessageReject MessageType=j.

BusinessMessageReject MessageType=j				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
45	RefSeqNum	SEQNUM	Ссылка на номер сообщения	N
372	RefMsgType	STRING	6 - IOI	Y
380	BusinessRejectReason	INT	Причина отказа 0 -	Y
58	Text	STRING	Описание	N

4.7 Сообщение NewOrderSingle

В таблице ниже описаны поля сообщения NewOrderSingle MessageType=D.

NewOrderSingle MessageType=D				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
11	ClOrdID	STRING	Идентификатор ордера	Y
41	OrigClOrdID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный клиентом	N
37	OrderID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный сервисом	N
40	OrdType	CHAR	Тип заявки 2 - LIMIT. Лимитированная	Y

60	TransactTime	TZTIMEONLY	Действительно с	Y
Parties			Участники	N
Instrument			Финансовый инструмент	Y
54	Side	CHAR	Справочник направлений 1 - BUY. Интерес в покупке 2 - SELL. Интерес в продаже	Y
38	OrderQty	QTY	Количество ценных бумаг в единицах	N
44	Price	PRICE	Цена за одну ценную бумагу	N
423	PriceType	INT	Тип цены 1 - PERCENTAGE. Процент	N
168	EffectiveTime	TZTIMEONLY	Действительно с	N
62	ValidUntilTime	TZTIMEONLY	Действительно по	N
64	SettlDate	LOCALMKTDATE	Дата расчетов	N
120	SettlCurrency	CURRENCY	Валюта расчетов	Y
172	SettlDeliveryType	INT	Тип поставки 0 - VERSUS_PAYMENT_DELIVER_PAYMENT. DVP 1 - FREE_DELIVER_FREE. FOP	N
100	ExDestination	EXCHANGE	Площадка: РПС МБ (биржевая) или ОТС(внебиржевая). Идентификатор площадки: "MISX" – РПС МБ, РПС, АРПС. "XOFF" – ОТС	Y
1133	ExDestinationIDSource	CHAR	Тип для поля ExDestination D - CUSTOM_CODE. Определен площадкой	N
5459	OptionSettlType	STRING	Код расчетов по сделке. Учитывается, если Место исполнения="РПС МБ"	N
1091	PreTradeAnonymity	BOOLEAN	Анонимно	N

113	ReportToExch	BOOLEAN	Отправить ли отчет в OTC-монитор по итогам заключения сделки. Учитывается, если Место исполнения="OTC" N - INDICATES_THE_PARTY_SENDING_MESSAGE_WILL_REPORT_TRADE. Да Y - INDICATES_THE_PARTY_RECEIVING_MESSAGE_MUST_REPORT_TRADE. Нет	N
528	OrderCapacity	CHAR	За чей счет A - AGENCY. За счет клиента P - PRINCIPAL. За свой счет W - AGENT_FOR_OTHER_MEMBER. За счет Д.У.	N
7001	NegotiationID	STRING	Идентификатор объекта Negotiation. Если на базе существующего IOI, то принимается из клиента	N
75	TradeDate	LOCALMK TDATE	Дата	Y
504	PaymentDate	LOCALMK TDATE	Дата платежа	N
743	DeliveryDate	LOCALMK TDATE	Дата поставки	N
155	SettlCurrFxRate	FLOAT	Курс	N
156	SettlCurrFxRateCalc	CHAR	Способ расчета курса: MULTIPLY M - MULTIPLY. D - DIVIDE.	N
1446	RateSource	INT	Источник курса: ЦБ или в ручную 0 - CENTRALBANK. 1 - MANUAL. 2 - IGNORE.	N
58	Text	STRING	Описание	N
494	Designation	STRING	Комментарий	N
7004	BrokerRef	STRING	Ссылка brokerref	N
221	BenchmarkCurveName	STRING	Источник референсной исходной цены. Интерфакс.	N

662	BenchmarkPrice	PRICE	Значение исходной цены	N
DiscretionInstructions		Параметры смещения цены		N

4.8 Сообщение OrderCancelRequest

В таблице ниже описаны поля сообщения OrderCancelRequest MessageType=F.

OrderCancelRequest MessageType=F				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
11	ClOrdID	STRING	Идентификатор ордера	Y
41	OrigClOrdID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный клиентом	N
37	OrderID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный сервисом	N
40	OrdType	CHAR	Тип заявки 2 - Лимитированная	Y
60	TransactTime	UTCTIMESTAMP	Действительно с	Y
<u>Parties</u>			Участники	N
<u>Instrument</u>			Финансовый инструмент	Y
54	Side	CHAR	Справочник направлений 1 - Интерес в покупке 2 - Интерес в продаже 7 - Двухнаправленный интерес (Только IOI)	Y
<u>TargetParties</u>			В направлении участников	N
38	OrderQty	QTY	Количество ценных бумаг в единицах	N
100	ExDestination	EXCHANGE	Площадка: РПС МБ (биржевая) или ОТС(внебиржевая). Идентификатор площадки: "MISX" – РПС МБ, РПС, АРПС. "XOFF" – ОТС	N
1133	ExDestinationIDSource	CHAR	Тип для поля ExDestination G - Определен площадкой	N
7001	NegotiationID	STRING	Идентификатор объекта Negotiation. Если на базе существующего IOI, то принимается из клиента	N

4.9 Сообщение OrderCancelReject

В таблице ниже описаны поля сообщения OrderCancelReject MessageType=9.

OrderCancelReject MessageType=9				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
37	OrderID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный сервисом	Y
11	ClOrdID	STRING	Идентификатор ордера	Y

41	OrigClOrdID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный клиентом	N
39	OrdStatus	CHAR	Статус ордера 0 - Активен 2 - Исполнен 4 - Отменен 6 - В процессе отмены 8 - Отклонен A - Принят системой C - Снят по времени	Y
60	TransactTime	UTCTIMESTAMP	Действительно с	N
434	CxlRejResponseTo	STRING	Тип запроса 1 - Отмена запроса 2 - Отмена/Замена запроса	Y
102	CxlRejReason	INT	Причина отмены 99 - Другая	N
1328	RejectText	STRING	Текст описания причины отказа	N
Parties			Участники	N
100	ExDestination	EXCHANGE	Площадка: РПС МБ (биржевая) или ОТС(внебиржевая). Идентификатор площадки: "MISX" – РПС МБ, РПС, АРПС. "XOFF" – ОТС	N
1133	ExDestinationIDSource	CHAR	Тип для поля ExDestination G - Определен площадкой	N
7001	NegotiationID	STRING	Идентификатор объекта Negotiation. Если на базе существующего IOI, то принимается из клиента	N

4.10 Сообщение SecurityListRequest

В таблице ниже описаны поля сообщения SecurityListRequest MessageType=x.

SecurityListRequest MessageType=x				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса списка доступных инструментов	Y
559	SecurityListRequestType	INT	Тип критерия отбора инструментов 4 - Все инструменты	Y
263	SubscriptionRequestType	CHAR	Тип запроса 0 - Получение списка snapshot	N
1465	SecurityListID	STRING	Идентификатор списка инструментов к загрузке: ACTIVE	N
Instrument			Финансовый инструмент	N

4.11 Сообщение SecurityList

В таблице ниже описаны поля сообщения SecurityList MessageType=y.

SecurityList MessageType=y				
----------------------------	--	--	--	--

Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
964	SecurityReportID	INT	Идентификатор запроса	N
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса списка доступных инструментов	N
1465	SecurityListID	STRING	Идентификатор списка инструментов к загрузке: ACTIVE	N
560	SecurityRequestResult	INT	Статус ответа 0 - Верный запрос 1 - Неверный запрос 2 - Нет инструментов 3 - Отказ неавторизованному 4 - Сервис недоступен 5 - Запрос не поддерживается	N
393	TotNoRelatedSym	INT	Количество инструментов	N
1301	MarketID	EXCHANGE	Критерий отбора инструментов по рынку: По умолчанию - все инструменты, MISC для указания площадки, (MISC) для MOEX, (XOFF) для OTC	N
1300	MarketSegmentID	STRING	Сегмент рынка	N
	SecListGrp		Список инструментов	N

4.12 Сообщение ExecutionReport

В таблице ниже описаны поля сообщения ExecutionReport MessageType=8.

ExecutionReport MessageType=8				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
37	OrderID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный сервисом	Y
11	ClOrdID	STRING	Идентификатор ордера	N
41	OrigClOrdID	STRING	Идентификатор ордера, присвоенный клиентом	N
880	TrdMatchID	STRING	Идентификатор мэтчинга в системе, где он был проведен	N
17	ExecID	STRING	Уникальный идентификатор репорта	Y
19	ExecRefID	STRING	Идентификатор репорта, который корректируется	N
150	ExecType	CHAR	Тип исполнения 0 - NEW. Принят в исполнение 4 - CANCELED. Отменен 6 - PENDING_CANCEL. В процессе отмены 8 - REJECTED. Отклонен A - PENDING_NEW. Получен, обработан C - EXPIRED. Истечение срока	Y

			F - TRADE. Исполнен полностью I - ORDER_STATUS. Ответ на статус репорт	
243 1	ExecTypeReason	STRING	Дополнительная информация к ExecType	N
39	OrdStatus	CHAR	Статус ордера 0 - NEW. Активен 2 - FILLED. Исполнен 4 - CANCELED. Отменен 6 - PENDING_CANCEL. В процессе отмены 8 - REJECTED. Отклонен A - PENDING_NEW. Принят системой C - EXPIRED. Снят по времени	Y
103	OrdRejReason	INT	Идентификатор ошибки при отклонении ордера 99 - OTHER.	N
132 8	RejectText	STRING	Текст описания причины отказа	N
Parties			Участники	Y
Instrument			Финансовый инструмент	Y
40	OrdType	CHAR	Тип заявки 2 - LIMIT. Лимитированная	Y
109 1	PreTradeAnonymity	BOOLEAN	Анонимно	N
30	LastMkt	EXCHANGE		N
75	TradeDate	LOCALMKTDAT E	Дата	Y
60	TransactTime	TZTIMEONLY	Действительно с	Y
168	EffectiveTime	TZTIMEONLY	Действительно с	N
62	ValidUntilTime	TZTIMEONLY	Действительно по	N
54	Side	CHAR	Справочник направлений 1 - BUY. Интерес в покупке 2 - SELL. Интерес в продаже 7 - UNDISCLOSED. Двухнаправленный интерес (Только IOI)	Y
38	OrderQty	QTY	Количество ценных бумаг в единицах	N

44	Price	PRICE	Цена за одну ценную бумагу	N
423	PriceType	INT	Тип цены 1 - PERCENTAGE. Процент	N
64	SettleDate	LOCALMKTDAT E	Дата расчетов	N
120	SettleCurrency	CURRENCY	Валюта расчетов	N
172	SettleDeliveryType	INT	Тип поставки 0 - VERSUS_PAYMENT_DELIVER_PAYMENT. DVP 1 - FREE_DELIVER_FREE. FOP	N
100	ExDestination	EXCHANGE	Площадка: РПС МБ (биржевая) или OTC(внебиржевая). Идентификатор площадки: "MISX" – РПС МБ, РПС, АРПС. "XOFF" – OTC	N
113 3	ExDestinationIDSource	CHAR	Тип для поля ExDestination D - CUSTOM_CODE. Определен площадкой	N
545 9	OptionSettleType	STRING	Код расчетов по сделке. Учитывается, если Место исполнения="РПС МБ"	N
113	ReportToExch	BOOLEAN	Отправить ли отчет в OTC-монитор по итогам заключения сделки. Учитывается, если Место исполнения="OTC" N - INDICATES_THE_PARTY_SENDING_MESSAGE_WILL_RE PORT_TRADE. Да Y - INDICATES_THE_PARTY_RECEIVING_MESSAGE_MUST_ REPORT_TRADE. Нет	N
528	OrderCapacity	CHAR	За чей счет A - AGENCY. За счет клиента P - PRINCIPAL. За свой счет W - AGENT_FOR_OTHER_MEMBER. За счет Д.У.	N
700 1	NegotiationID	STRING	Идентификатор объекта Negotiation. Если на базе существующего IOI, то принимается из клиента	N
504	PaymentDate	LOCALMKTDAT E	Дата платежа	N
743	DeliveryDate	LOCALMKTDAT E	Дата поставки	N

MiscFeesGrp			Комиссия	N
381	GrossTradeAmt	AMT	Сумма по соглашению без НКД в валюте номинала	N
159	AccruedInterestAmt	AMT	НКД	N
119	SettlCurrAmt	AMT	Сумма с НКД в валюте расчетов	N
700 2	settlementAmount	AMT	Сумма по соглашению без НКД в валюте расчетов	N
700 3	settlementAccrued	AMT	НКД по соглашению в валюте расчета	N
155	SettlCurrFxRate	FLOAT		N
156	SettlCurrFxRateCalc	CHAR	Способ расчета курса: MULTIPLY M - MULTIPLY. D - DIVIDE.	N
144 6	RateSource	INT	Источник курса: ЦБ или в ручную 0 - CENTRALBANK. 1 - MANUAL. 2 - IGNORE.	N
58	Text	STRING	Описание	N
494	Designation	STRING	Комментарий	N
700 4	BrokerRef	STRING	Ссылка brokerref	N
221	BenchmarkCurveName	STRING	Источник референсной исходной цены. Интерфакс.	N
662	BenchmarkPrice	PRICE	Значение исходной цены	N
DiscretionInstructions		Параметры смещения цены		N
CommissionData		Данные о комиссии		N

4.13 Сообщение PartyDetailsListRequest

В таблице ниже описаны поля сообщения PartyDetailsListRequest MessageType=CF.

PartyDetailsListRequest MessageType=CF				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
964	SecurityReportID	INT	Идентификатор запроса	N

1505	PartyDetailsListRequestID	STRING		Y
263	SubscriptionRequestType	CHAR	Тип запроса 0 - Получение списка snapshot	Y
452	PartyRole	INT	Роль участника 3 - Клиент 7 - Фирма 11 - Инициатор Трейдер 13 - Инициатор Участник 17 - Контрагент 24 - Клиентский счет 36 - Трейдер 56 - Допустимый контрагент	N

4.14 Сообщение PartyDetailsListReport

В таблице ниже описаны поля сообщения PartyDetailsListReport MessageType=CG.

PartyDetailsListReport MessageType=CG				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
1510	PartyDetailsListReportID	STRING		Y
1505	PartyDetailsListRequestID	STRING		Y
1511	RequestResult	INT	Статус ответа 0 - Валидный запрос 1 - Неважный запрос 2 - Не найдено контрагентов, удовлетворяющих критерию 3 - Отказ неавторизованному 4 - Сервис недоступен 5 - Запрос не поддерживается 99 - Иное (RejectText 1328 для деталей)	N
1328	RejectText	STRING	Текст описания причины отказа	N
1512	TotNoParties	INT	Общее количество контрагентов в списке.	N
PartyDetailGrp				N

4.15 Сообщени SecurityListRequest для коммерческих облигаций

В таблице ниже описаны поля сообщения SecurityListReport MessageType=y.

Tag #	Параметр	Тип	Примечание	O
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса	O
559	SecurityListRequestType	INT	6 – Запрос по коммерческим облигациям	O
560	SubscriptionRequestType	CHAR	Тип запроса:	O
			(0) Snapshot Снепшот	
1465	SecurityListID	STRING	Активный список. Значение «ACTIVE»	O

Component	Instrument			
48	SecurityID	STRING	Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue)	
22	SecurityIDSource	STRING	в системе OTC.	
55	Symbol	STRING	Наименование инструмента для пользователя	

4.15.1 Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций

Данное сообщение будет возвращаться в ответ на SecurityListRequest с SecurityListRequestType = 6 и содержать расширенную информацию по коммерческим облигациям.

Tag #	Параметр	O	Описание	O
964	SecurityReportID	STRING	Идентификатор сообщения	O
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса, в рамках которого сформирован список	O
1465	SecurityListID	STRING	ACTIVE Идентификатор списка инструментов к загрузке	O
560	SecurityRequestResult	INT	Статус ответа: (0) Валидный запрос (1) Неважный запрос (2) Не найдено инструментов, удовлетворяющих критерию (3) Отказ неавторизованному (4) Сервис недоступен (5) Запрос не поддерживается	O
1607	SecurityRejectReason	STRING	Описание ошибки	
393	TotNoRelatedSym	INT	Общее число инструментов в списке	
Component	SecListGrp			

146	NoRelatedSym	INT	количество инструментов в группе	
Component	Intrument		Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue) в системе ОТС.	
	(22)SecurityID			
	(48)SecurityIDSource			
55	Symbol	STRING	Наименование инструмента для пользователя (humanreadable, совпадает с ISIN в UI)	
965	SecurityStatus	INT	Статус	
			(1) Active - Активная	
106	Issuer	STRING	Наименование эмитента	
2737	FinancialInstrumentShortName	STRING	Краткое наименование бумаги	
2714	FinancialInstrumentFullName	STRING	Полное наименование бумаги	
762	securitySubType	STRING	Коммерческие облигации	
541	maturityDate	LocalMktDate	Дата погашения	
224	CouponPaymentDate	LocalMktDate	Дата выплаты	
223	CouponRate	Percentage	Ставка купона,%	
167	securityType	STRING	Облигации: CORP	
Component	InstrumentExtension	STRING	Расширение инструмента	
Component	AttrbGrp		Группа атрибутов	
871	InstrAttribType[registerNumber]	STRING	Регистрационный номер	
871	InstrAttribType[qualifiedInvestors]	STRING	Для квал.инвесторов	
871	InstrAttribType[volumeQty]	STRING	Объем выпуска в штуках	
871	InstrAttribType[nominalCurrency]	STRING	Валюта номинала	

871	InstrAttribType[couponStartDate]	STRING	Дата начала купона	
871	InstrAttribType[firstCouponDate]	STRING	Дата окончания купона	
871	InstrAttribType[nominal]	STRING	Номинал	
Component	SecurityTradingRules	STRING	Компонент правила торгов	
Component	BaseTradingRules		Компонент базовые правила торгов	
561	RoundLog	QTY	Размер лота	

4.16 Сообщение PricingFactorRequest для коммерческих облигаций

В таблице ниже описаны поля сообщения PricingFactorRequest MessageType=уу для запроса информации ценообразования коммерческих облигаций.

Tag #	Параметр	Тип	Примечание	
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса	0
559	SecurityListRequestType	INT	6 – Запрос по коммерческих облигациям	0
560	SubscriptionRequestType	CHAR	Тип запроса:	0
			(0) Snapshot Снепшот	
1465	SecurityListID	STRING	Активный список. Значение «ACTIVE»	0
Component	Instrument			
48	SecurityID	STRING	Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue)	
22	SecurityIDSource	STRING	в системе OTC.	
55	Symbol	STRING	Наименование ISIN инструмента для пользователя	
Component	EventGroup			
Component	NoEvents			
865	EventType	INT	Тип события: 99 – Other.	
866	EventDate	LOCALMKTDATE	Дата данных для облигаций в формате YYYYMMDD.	

			Обязательное для задания EventType.	
--	--	--	-------------------------------------	--

4.16.1 Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций

Данное сообщение будет возвращаться в ответ на PricingFactorRequest с SecurityListRequestType = 6 и содержать расширенную информацию по коммерческим облигациям в части ценообразования.

Tag #	Параметр	O	Описание	O
964	SecurityReportID	STRING	Идентификатор сообщения	O
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса, в рамках которого сформирован список	O
1465	SecurityListID	STRING	ACTIVE	O
			Идентификатор списка инструментов к загрузке	
560	SecurityRequestResult	INT	Статус ответа:	O
			(0) Валидный запрос	
			(1) Неважный запрос	
			(2) Не найдено инструментов, удовлетворяющих критерию	
			(3) Отказ неавторизованному	
			(4) Сервис недоступен	
(5) Запрос не поддерживается				
1607	SecurityRejectReason	STRING	Описание ошибки	
393	TotNoRelatedSym	INT	Общее число инструментов в списке	
Component	SecListGrp			
146	NoRelatedSym	INT	количество инструментов в группе	

Component	Intrument		Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue) в системе OTC.	
	(22)SecurityID			
	(48)SecurityIDSource			
55	Symbol	STRING	Наименование инструмента для пользователя (humanreadable, совпадает с ISIN в UI)	
965	SecurityStatus	INT	Статус	
			(1) Active - Активная	
2737	FinancialInstrumentShortName	STRING	Краткое наименование бумаги	
2714	FinancialInstrumentFullName	STRING	Полное наименование бумаги	
762	securitySubType	STRING	Коммерческие облигации	
167	securityType	STRING	Облигации: CORP	
Component	InstrumentExtension	STRING	Расширение инструмента	
Component	AttrbGrp		Группа атрибутов	
871	InstrAttribType[accruedint]	STRING	НКД в валюте номинала	
871	InstrAttribType[nominal]	STRING	Текущий номинал на дату	
871	InstrAttribType[couponRate]	STRING	Ставка купона,%	
871	InstrAttribType[valueDate]	STRING	Дата значений	

4.17 Сообщение **CouponPeriodRequest** для коммерческих облигаций

В таблице ниже описаны поля сообщения **CouponPeriodRequest** MessageType=ux для запроса купонного расписания коммерческих облигаций.

Tag #	Параметр	Тип	Примечание	
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса	0
559	SecurityListRequestType	INT	6 – Запрос по коммерческих облигациям	0

560	SubscriptionRequestType	CHAR	Тип запроса:	0
			(0) Snapshot Снепшот	
1465	SecurityListID	STRING	Активный список. Значение «ACTIVE»	0
Component	Instrument			
48	SecurityID	STRING	Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue)	
22	SecurityIDSource	STRING	в системе OTC.	
55	Symbol	STRING	Наименование ISIN инструмента для пользователя	
Component	EventGroup			
Component	NoEvents			
865	EventType	INT	Тип события: 99 – Other.	
866	EventDate	LOCALMKTDATE	Дата данных для облигаций в формате YYYYMMDD. Обязательное для задания EventType.	

4.17.1 Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций

Данное сообщение будет возвращаться в ответ на CouponPeriodRequest с SecurityListRequestType = 6 и содержать расширенную информацию по коммерческим облигациям в части ценообразования.

Tag #	Параметр	O	Описание	O
964	SecurityReportID	STRING	Идентификатор сообщения	0
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса, в рамках которого сформирован список	0
1465	SecurityListID	STRING	ACTIVE	0
			Идентификатор списка инструментов к загрузке	

560	SecurityRequestResult	INT	Статус ответа:	0
			(0) Валидный запрос	
			(1) Неважный запрос	
			(2) Не найдено инструментов, удовлетворяющих критерию	
			(3) Отказ неавторизованному	
			(4) Сервис недоступен	
(5) Запрос не поддерживается				
1607	SecurityRejectReason	STRING	Описание ошибки	
393	TotNoRelatedSym	INT	Общее число инструментов в списке	
Component	SecListGrp			
146	NoRelatedSym	INT	количество инструментов в группе	
Component	Intrument		Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue) в системе OTC.	
	(22)SecurityID			
	(48)SecurityIDSource			
55	Symbol	STRING	Наименование инструмента для пользователя (humanreadable, совпадает с ISIN в UI)	
965	SecurityStatus	INT	Статус	
			(1) Active - Активная	
2737	FinancialInstrumentShortName	STRING	Краткое наименование бумаги	
2714	FinancialInstrumentFullName	STRING	Полное наименование бумаги	
762	securitySubType	STRING	Коммерческие облигации	

167	securityType	STRING	Облигации: CORP	
Component	InstrumentExtension	STRING	Расширение инструмента	
Component	AttrbGrp		Группа атрибутов	
871	InstrAttribType[periodEndDate]	STRING	Дата завершения купона	
871	InstrAttribType[periodStartDate]	STRING	Дата начала купона	
871	InstrAttribType[couponRate]	STRING	Ставка купон	
871	InstrAttribType[couponValue]	STRING	Значение купона	

4.18 Сообщение AmortizationPeriodRequest для коммерческих облигаций

В таблице ниже описаны поля сообщения AmortizationPeriodRequest MessageType=yz для запроса амортизационного расписания коммерческих облигаций.

Tag #	Параметр	Тип	Примечание	
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса	O
559	SecurityListRequestType	INT	6 – Запрос по коммерческих облигациям	O
560	SubscriptionRequestType	CHAR	Тип запроса:	O
			(0) Snapshot Снепшот	
1465	SecurityListID	STRING	Активный список. Значение «ACTIVE»	O
Component	Instrument			
48	SecurityID	STRING	Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue)	
22	SecurityIDSource	STRING	в системе OTC.	
55	Symbol	STRING	Наименование ISIN инструмента для пользователя	
Component	EventGroup			
Component	NoEvents			
865	EventType	INT	Тип события: 99 – Other.	

866	EventDate	LOCALMKTDATE	Дата данных для облигаций в формате YYYYMMDD. Обязательное для задания EventType.	
-----	-----------	--------------	---	--

4.18.1 Сообщение SecurityList для коммерческих облигаций

Данное сообщение будет возвращаться в ответ на AmortizationPeriodRequest с SecurityListRequestType = 6 и содержать расширенную информацию по коммерческим облигациям в части ценообразования.

Tag #	Параметр	О	Описание	О
964	SecurityReportID	STRING	Идентификатор сообщения	О
320	SecurityReqID	STRING	Идентификатор запроса, в рамках которого сформирован список	О
1465	SecurityListID	STRING	ACTIVE	О
			Идентификатор списка инструментов к загрузке	
560	SecurityRequestResult	INT	Статус ответа:	О
			(0) Валидный запрос	
			(1) Неважный запрос	
			(2) Не найдено инструментов, удовлетворяющих критерию	
			(3) Отказ неавторизованному	
			(4) Сервис недоступен	
(5) Запрос не поддерживается				
1607	SecurityRejectReason	STRING	Описание ошибки	
393	TotNoRelatedSym	INT	Общее число инструментов в списке	
Component	SecListGrp			
146	NoRelatedSym	INT	количество инструментов в группе	

Component	Intrument		Идентификатор ценной бумаги в виде идентификатора инструмента (issue) в системе OTC.	
	(22)SecurityID			
	(48)SecurityIDSource			
55	Symbol	STRING	Наименование инструмента для пользователя (humanreadable, совпадает с ISIN в UI)	
965	SecurityStatus	INT	Статус	
			(1) Active - Активная	
2737	FinancialInstrumentShortName	STRING	Краткое наименование бумаги	
2714	FinancialInstrumentFullName	STRING	Полное наименование бумаги	
762	securitySubType	STRING	Коммерческие облигации	
167	securityType	STRING	Облигации: CORP	
Component	InstrumentExtension	STRING	Расширение инструмента	
Component	AttrbGrp		Группа атрибутов	
871	InstrAttribType[recordDate]	STRING	Дата фиксации	
871	InstrAttribType[paymentDate]	STRING	Дата выплаты	
871	InstrAttribType[amortizationValue]	STRING	Амортизация в валюте номинала	
871	InstrAttribType[amortizationDate]	STRING	Дата амортизации	

5 Получение пропущенных данных и истории

В данном разделе описаны сообщения и сценарии для получения пропущенных данных и получения всей истории данных с начала торгового дня.

5.1 Общее описание

Ниже находится список правил, на базе которых организуется получение пропущенных данных и истории.

1. Система хранит данные о номерах сессии FIX протокола клиентов и сопоставляет им идентификатор последнего сообщения с бизнес-объектом, отправленного в рамках торгового дня.
2. По номеру в FIX сессии определяется список пропущенных данных и направляются все бизнес-объекты, созданные после сохраненного идентификатора.
3. Нумерация сообщений FIX сессии хранится только для текущего торгового дня.
4. В случае перезапуска сервера системы все соединения теряются, включая идентификаторы последнего сообщения.

5.2 Получение пропущенных данных

При соединении FIX клиента в сообщении Logon (A) необходимо указывать значение поля NextExpectedMsgSecNum(789), с целью получения сообщений за торговый день по объектам IOI, QUOTE, ORDER, EXECUTION пропущенным в системе. В значении должен быть передан последний успешный номер. В случае, если сообщается другой номер, то будут переданы только пропущенные данные. Формирование объектов сервером производится по идентификаторам объектов, номер которых больше того, что числится за клиентским местом, основываясь на его последнем идентификаторе.

Последний номер сессии сообщается в каждом FIX сообщении на транспортном уровне в поле MsgSecNum(34).

5.3 Получение истории

Получение истории торгового дня возможно в случае, если FIX клиент соединяется первый раз для получения данных, либо указано намеренный перезапрос данных одним из следующих способов при формировании сообщения FIX:

№	Способ	Описание
1	ResetSeqNumFlag(141) = Y	Установка флага сброса номеров сообщений для получения истории.
2	NextExpectedMsgSecNum(789) = 0	Установка номера сессии с нуля или начала торгового дня

5.4 Описание сообщений для истории и пропущенных данных

При получении истории или пропущенных данных не воспроизводятся короткие подтверждающие сообщения с ограниченным списком полей QuoteAck, а получают данные с широким списком полей QuoteResponse. Такое правило действительно для всех типов запросов IOI, Quote, Order.

Следующие объекты стоит ожидать во время получения истории и пропущенных данных со следующими статусами.

Для объектов IOI – Индикаций.

№	Объект	Вход./Исход.	Сообщение	Статус QuoteRespType
1	IOI	Исходящее	QuoteResponse	Cancelled (94)
2	IOI	Исходящее	QuoteResponse	Announced (91)
3	IOI	Исходящее	QuoteResponse	Expired (95)

4	IOI	Исходящее	QuoteResponse	Pending (90)
5	IOI	Исходящее	QuoteResponse	Rejected (92)
6	IOI	Исходящее	QuoteResponse	Matched (93)
7	IOI	Входящее	IOI	IOITransType=NEW
8	IOI	Входящее	IOI	IOITransType=CANCEL

Для объектов Quote – Котировки.

№	Объект	Вход./Исход.	Сообщение	Статус QuoteRespType
1	Quote	Исходящее	QuoteResponse	Cancelled (94)
2	Quote	Исходящее	QuoteResponse	Announced (91)
3	Quote	Исходящее	QuoteResponse	Expired (95)
4	Quote	Исходящее	QuoteResponse	Pending (90)
5	Quote	Исходящее	QuoteResponse	Rejected (92)
6	Quote	Исходящее	QuoteResponse	Matched (93)
7	Quote	Входящее	Quote	
8	Quote	Входящее	QuoteCancel	
9	Quote	Входящее	QuoteResponse	Rejected (92)
10	Quote	Входящее	QuoteResponse	Expired (95)

Для объектов Order – Котировки.

№	Объект	Вход./Исход.	Сообщение	Статус QuoteRespType
1	Order	Исходящее	ExecutionReport	Cancelled (4)
2	Order	Исходящее	ExecutionReport	New (0)
3	Order	Исходящее	ExecutionReport	Expired (C)
4	Order	Исходящее	ExecutionReport	Filled (2)
5	Order	Исходящее	ExecutionReport	Rejected (8)
6	Order	Входящее	NewSingleOrder	
7	Order	Входящее	OrderCancelRequest	
8	Order	Входящее	ExecutionReport	Expired (C)
9	Order	Входящее	ExecutionReport	Rejected (8)

6 Описание компонентов

В данном разделе описаны компоненты-группы полей.

6.1 Компонента Instrument

В таблице ниже описаны поля компонента Instrument.

Instrument				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
48	SecurityID	STRING	Идентификатор ценной бумаги	N
22	SecurityIDSource	STRING	Источник ценной бумаги M - Идентификатор OTC	N
55	Symbol	STRING	Наименование инструмента	N
SecAltIDGrp			Дополнительная группировка	N
541	MaturityDate	LOCALMKTDATE	Дата погашения	N

965	SecurityStatus	STRING	Статус ценной бумаги 1 - Активна 2 - Не активна	N
106	Issuer	STRING	Эмитент	N
2737	FinancialInstrumentShortName	STRING	Наименование ценной бумаги	N
2714	FinancialInstrumentFullName	STRING	Полное наименование ценной бумаги	N
SecurityTradingRules				N

6.2 Компонента SecAltIDGrp

В таблице ниже описаны поля компонента SecAltIDGrp.

SecAltIDGrp				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
455	SecurityAltID	STRING		N
456	SecurityAltIDSource	STRING		N

6.3 Компонента SecurityTradingRules

В таблице ниже описаны поля компонента SecurityTradingRules.

SecurityTradingRules				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
BaseTradingRules				N

6.4 Компонента BaseTradingRules

В таблице ниже описаны поля компонента BaseTradingRules.

BaseTradingRules				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
TickRules				N
LotTypeRules				N
PriceLimits				N
827	ExpirationCycle	INT	0 - 1 - 2 -	N
562	MinTradeVol	QTY		N
1140	MaxTradeVol	QTY		N
1143	MaxPriceVariation	FLOAT		N
1144	ImpliedMarketIndicator	INT	0 - 1 - 2 - 3 -	N
1245	TradingCurrency	CURRENCY		N
561	RoundLot	QTY		N

1377	MultilegModel	INT	0 - 1 - 2 -	N
1378	MultilegPriceMethod	INT	0 - 1 - 2 - 3 - 4 - 5 -	N
423	PriceType	INT	Тип цены 1 - Процент	N

6.5 Компонента TickRules

В таблице ниже описаны поля компонента TickRules.

TickRules				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
1206	StartTickPriceRange	PRICE		N
1207	EndTickPriceRange	PRICE		N
1208	TickIncrement	PRICE		N
1209	TickRuleType	INT	0 - 1 - 2 - 3 - 4 -	N

6.6 Компонента LotTypeRules

В таблице ниже описаны поля компонента LotTypeRules.

LotTypeRules				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
1093	LotType	CHAR	1 - 2 - 3 - 4 -	N
1231	MinLotSize	QTY		N

6.7 Компонента PriceLimits

В таблице ниже описаны поля компонента PriceLimits.

PriceLimits				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O

1306	PriceLimitType	INT	0 - 1 - 2 -	N
1148	LowLimitPrice	PRICE		N
1149	HighLimitPrice	PRICE		N
1150	TradingReferencePrice	PRICE		N

6.8 Компонента Parties

В таблице ниже описаны поля компонента Parties.

Следующие варианты могут использоваться в запросах многократно в разделе компоненты Parties:

- Чтобы задать клиента, то необходимо добавить блок с PartyRole: 3 – «Клиент».
- Чтобы задать фирму, то необходимо добавить блок с PartyRole: 7 – «Фирма».
- Чтобы задать контрагента, то необходимо добавить блок с PartyRole: 17 – «Клиент».

Другие значения указаны ниже в таблице.

Parties				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
448	PartyID	STRING	Идентификатор фирмы или значение в зависимости от значения PartyRole (452)	N
447	PartyIDSource	CHAR	Источник идентификатора D - Код OTC системы	N
452	PartyRole	INT	Роль участника 3 – Клиент 4 - CLEARING_FIRM. Идентификатор клиринга 7 - Фирма 11 - Инициатор Треjder 13 - Инициатор Участник 17 - Контрагент 24 - Клиентский счет 36 - Треjder 56 - Допустимый контрагент 7086 - CLEARING_PRODUCT. Идентификатор клирингового продукта	N

6.9 Компонента MiscFeesGrp

В таблице ниже описаны поля компонента MiscFeesGrp.

MiscFeesGrp				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
137	MiscFeeAmt	AMT	Объем	N
138	MiscFeeCurr	CURRENCY	Валюта 4 - Биржевой сбор	N
139	MiscFeeType	STRING	TODO: Тип TODO поле MiscFeeType	N
891	MiscFeeBasis	INT	Базис комиссии 0 - Абсолютное значение	N

6.10 Компонента SecListGrp

В таблице ниже описаны поля компонента SecListGrp.

SecListGrp				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
393	TotNoRelatedSym	INT	Количество инструментов	N
Instrument			Финансовый инструмент	N

6.11 Компонента PartyDetailGrp

В таблице ниже описаны поля компонента PartyDetailGrp.

PartyDetailGrp				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
1691	PartyDetailID	STRING		N
1692	PartyDetailIDSource	STRING	D -	N
452	PartyRole	INT	Роль участника 3 - Клиент 7 - Фирма 11 - Инициатор Трейдер 13 - Инициатор Участник 17 - Контрагент 24 - Клиентский счет 36 - Трейдер 56 - Допустимый контрагент	N
PartyDetailSubGrp				N

6.12 Компонента PartyDetailSubGrp

В таблице ниже описаны поля компонента PartyDetailSubGrp.

PartyDetailSubGrp				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
1695	PartyDetailSubID	STRING		N
1696	PartyDetailSubIDType	INT	1 - 5 -	N

6.13 Компонента CommissionData

В таблице ниже описаны поля компонента CommissionData – блока комиссии.

CommissionData				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
12	Commission	AMT	Значение комиссии	N
13	CommType	CHAR	1 - PER_UNIT. 2 - PERCENT. 3 - ABSOLUTE. 4 - PERCENTAGE_WAIVED_CASH_DISCOUNT.	N

			5 - PERCENTAGE_WAIVED_ENHANCED_UNITS. 6 - POINTS_PER_BOND_OR_CONTRACT.	
479	CommCurrency	CURRENCY	Рубли	N
497	FundRenewWaiv	CHAR	N - NO. Y - YES.	N

6.14 Компонента DiscretionInstructions

В таблице ниже описаны поля компонента DiscretionInstructions – блока смещения цены.

DiscretionInstructions				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
388	DiscretionInst	CHAR	Способ получения референтной цены 0 - RELATED_TO_DISPLAYED_PRICE. Со смещением	N
389	DiscretionOffsetValue	FLOAT	Значение смещения со знаком	N
842	DiscretionOffsetType	INT	Размерность смещения 0 - PRICE. В размерности цены 1 - BASIS_POINTS. Базисные пункты 2 - TICKS. Шаг цены	N

6.15 Компонента InstrumentExtention

В таблице ниже описаны поля компонента InstrumentExtention – Расширение инструмента.

InstrumentExtention				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
AttrGrp			Группа атрибутов	N

6.16 Компонента AttrGrp

DiscretionInstructions				
Tag	Наименование	Тип данных	Описание	O
870	NoInstrAttrib	Group	Количество атрибутов	N
872	InstrAttribValue	STRING	Значение атрибута	N
871	InstrAttribType	INT	Тип атрибута: 50 - 'REGISTER_NUMBER' Регистрационный номер 51 - 'QUALIFIED_INVESTORS' Для квалифицированных инвесторов 52 - 'VOLUME_QTY' Объем выпуска в штуках 53 - 'NOMINAL_CURRENCY' Валюта номинала 54 - 'COUPON_START_DATE' Дата начала купона 55 - 'FIRST_COUPON_DATE' Дата окончания купона 56 - 'NOMINAL' Номинал 57 - 'ACCRUEDINT' НКД в валюте номинала 58 - 'COUPON_RATE' Ставка купона	N

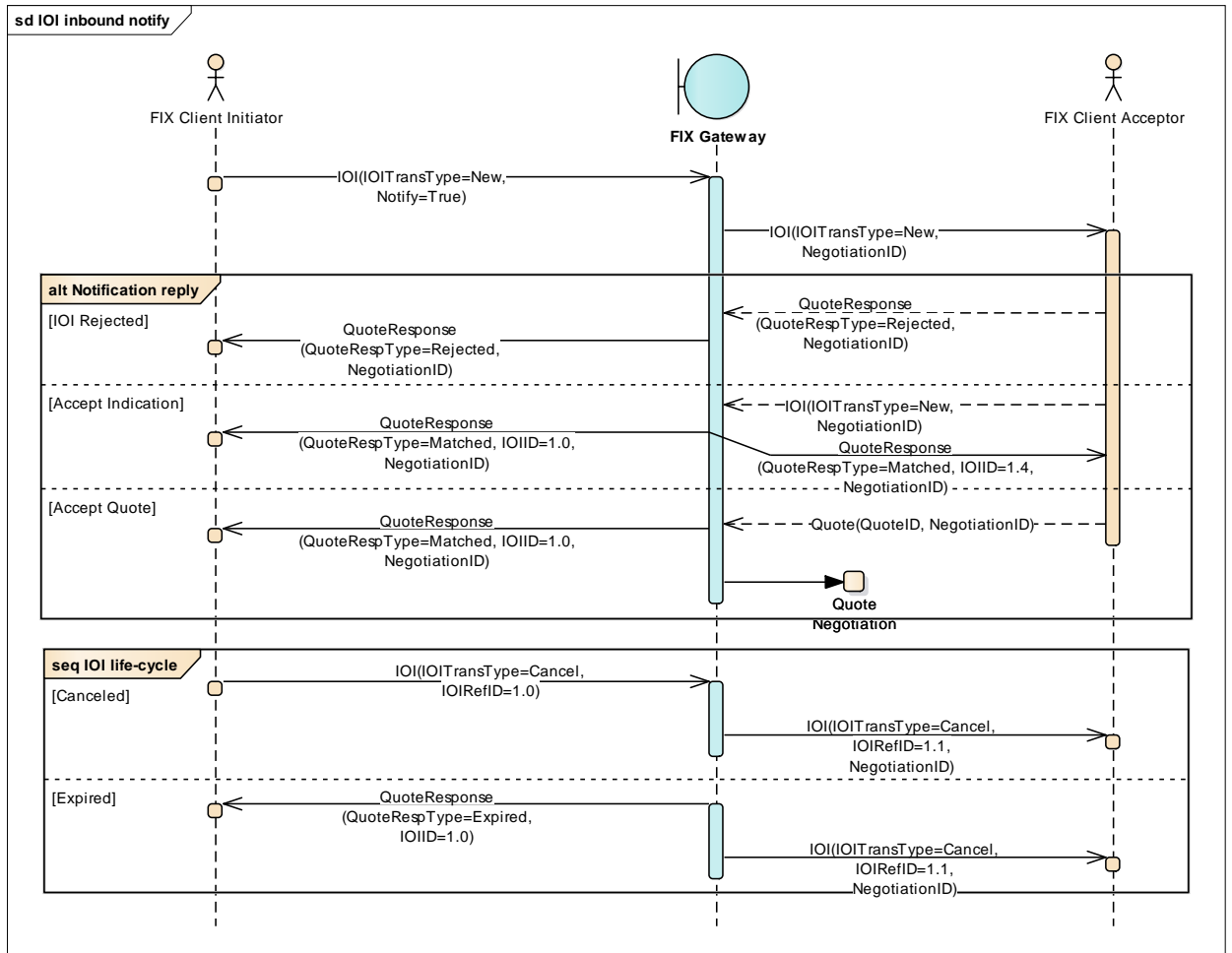
			59 - 'VALUE_DATE' Дата значений 60 - 'PERIOD_END_DATE' Дата завершения купона 61 - 'PERIOD_START_DATE' Дата начала купона 62 - 'COUPON_VALUE' Значение купона 63 - 'RECORD_DATE' Дата фиксации 64 - 'PAYMENT_DATE' Дата выплаты 65 - 'AMORTIZATION_VALUE' Амортизация в валюте номинала 66 - 'AMORTIZATION_DATE' Дата амортизации	
230	ExDate	LOCALMKTDATE	Дата значений атрибутов	

7 Диаграммы сообщений и комментарии

7.1 Сообщения IOI

IOI (indication of interest) – индикация интереса к ценной бумаге (покупка и/или продажа), адресованная от Участника Системе;

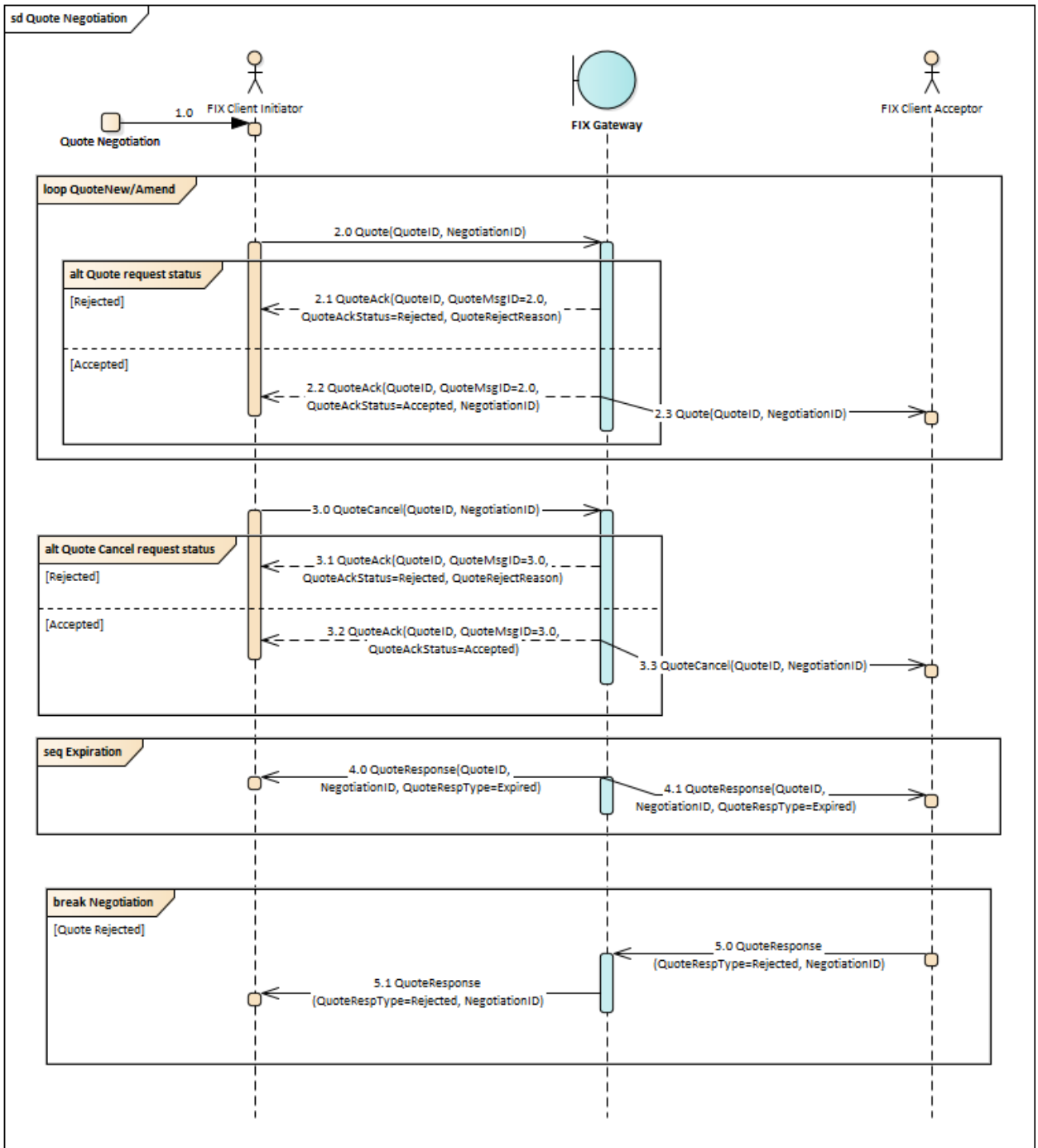
Ниже на диаграмме отображен обмен сообщениями IOI.



7.2 Обмен сообщениями QUOTE

Quote – предложение котировки (индикативная котировка), адресованное участнику системы;

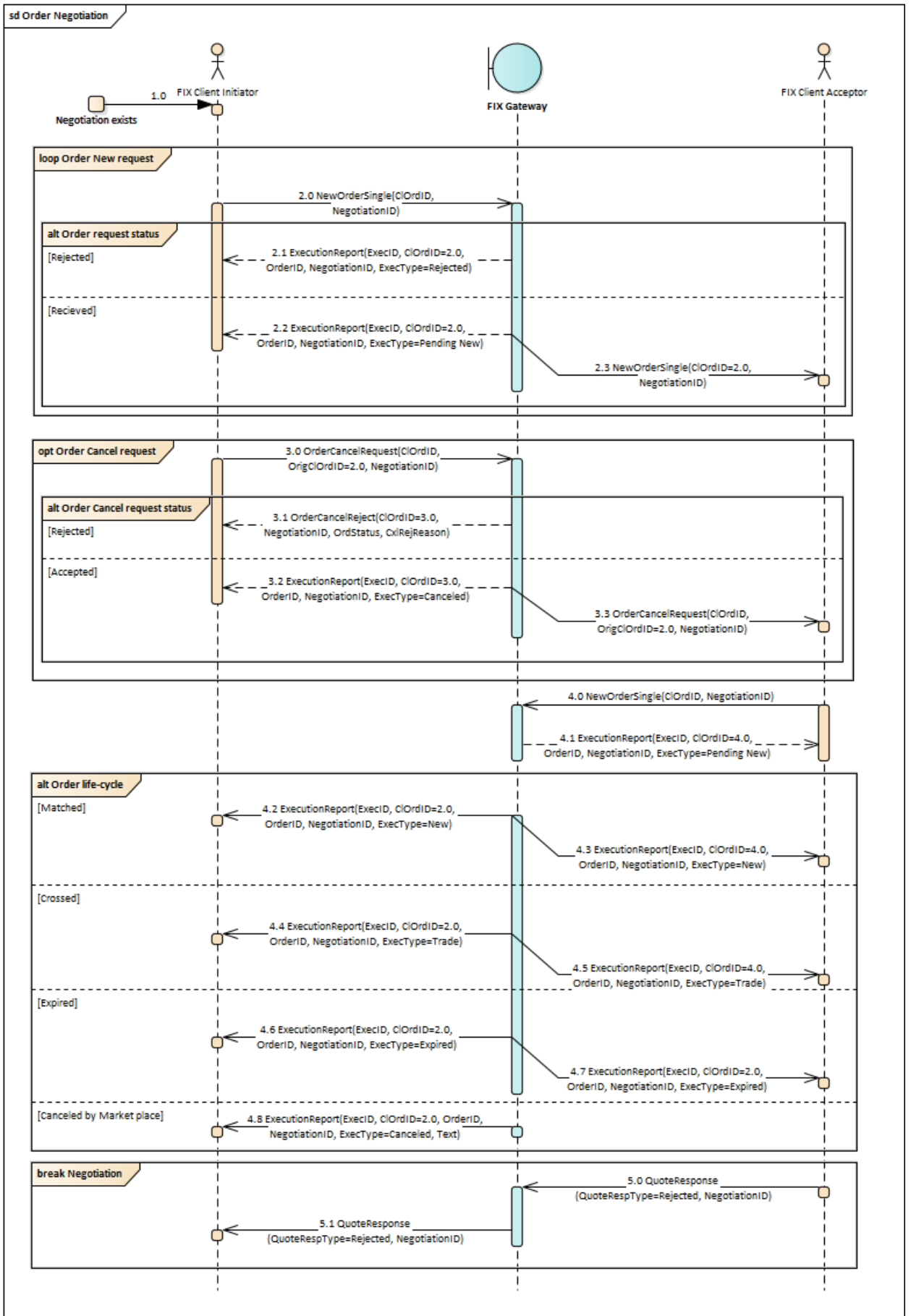
Ниже на диаграмме отображен обмен сообщениями для Quote.



7.3 Обмен сообщениями для ORDER

Ордер (твёрдая котировка или индикативный ордер) может подаваться любым участником Системы. Участник выражает своё намерение совершить сделку путём подачи ордера в систему, также ордера могут создаваться в ответ на Quote или на основе IOI .

Ниже на диаграмме отображен обмен сообщениями для Order.



7.4 Отмена переговоров

Отмена переговоров выполняется с помощью сообщения QuoteResponse (QuoteRespType=Rejected) и описана в диаграммах выше в разделе breakNegotiation.

7.5 Получение адресных сообщений

Получение адресных сообщений от участников системы реализуется следующими сообщениями

№	Уровень переговоров	Сообщение FIX	Комментарий
1	IOI	IOI	Адресное сообщение IOI
2	Quote	Quote	Адресное сообщение Quote
3	Order	NewOrderSingle	Адресное сообщение Order

7.6 Получение инструментов и контрагентов

Ниже на диаграмме отображено получение инструментов и контрагентов.

